

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2022

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	627.014,59	100%			0,98%	3,06%	6,33%	10,68%	11,47%	15,71%	18,31%	
Benchmark:	CDI				1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%	
Renda Fixa CDI	627.014,59	100%		0,02%								
BRADESCO FIRF REF. DI FEDERAL EXTRA	627.014,59	100%	BRADESCO	0,01%	0,02%	0,99%	3,08%	6,38%	10,84%	11,65%	15,82%	18,77%
Benchmark:	CDI				1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%	
Total	626.960,95	100%		0,02%	0,98%	3,06%	6,33%	10,68%	11,47%	15,71%	18,31%	
Benchmark:	CDI				1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%	

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

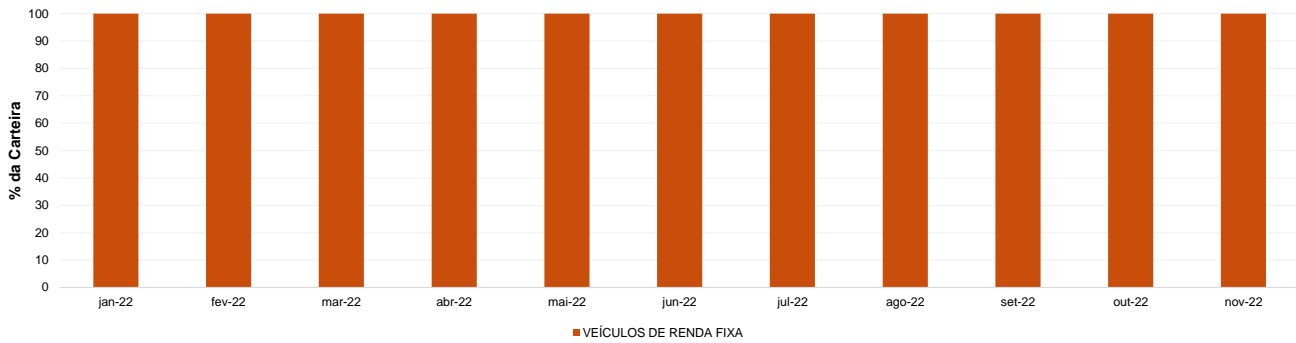
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2022

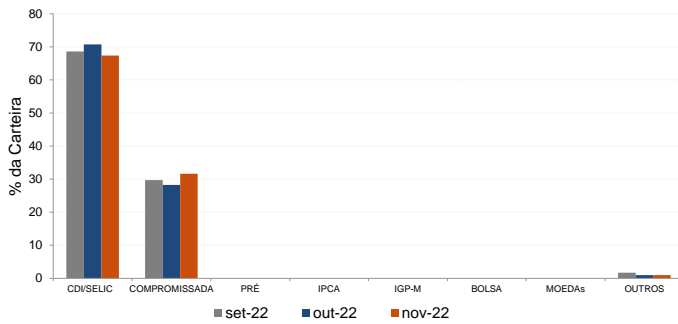
Distribuição da Carteira

O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

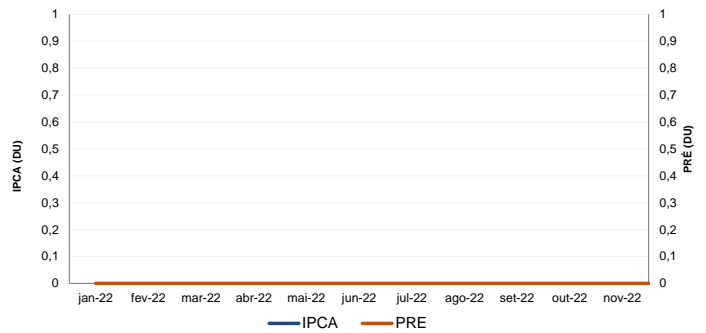
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2022

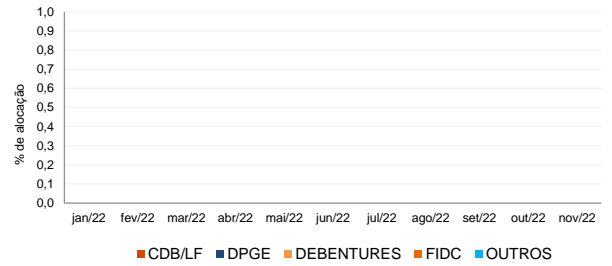
Análises de Contrapartes

A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
------	------	---	---------------------------

Alocação Por Tipo de Crédito



* em mil R\$

Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2022

Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos com alocação direta. É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-03-01	01-mar-23	13.433	2,14%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	8.744	1,39%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.622	0,42%	Selic	11-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.342	0,21%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	268	0,04%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	260	0,04%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	18	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	8.947	1,43%	Selic	14-nov-22	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	179	0,03%	Selic	21-nov-22	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	4.467	0,71%	Selic	24-nov-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.367	0,38%	Selic	23-nov-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT

